

BCV Fund (Lux) - BCV Liquid Alternative Beta C (USD)

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001010

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target
Allocation NR USD
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

HFRX Global Hedge Fund USD

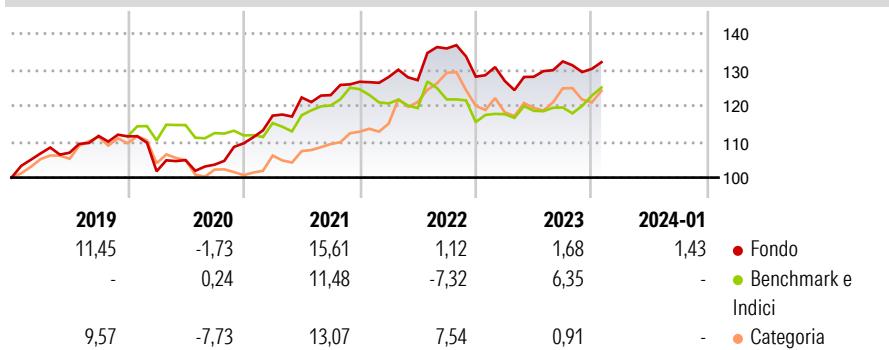
Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The objective of the sub-fund is to replicate the risk/return profile of an investment in a diversified portfolio of hedge funds. To achieve this, the managers apply a quantitative factorial regression management method.

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	0,90	3Y Sharpe Ratio	0,72
3Y Beta	0,58	3Y Std Dev	6,90
3Y R-Squared	57,04	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	0,39	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	5,17	10Y Risk	-

Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %

Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,30	-1,35
6-Mesi	4,95	2,24
1-Anno	3,46	-4,27
3-Anni Ann.ti	5,02	4,60
5-Anni Ann.ti	5,16	3,39
10-Anni Ann.ti	-	8,46

Rendimenti aggiornati al 12/02/2024

Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-	-	-	-
2024	-	-	-	-
2023	-0,92	0,91	3,32	-1,57
2022	1,04	-0,68	6,92	-5,76

Portafoglio 31/12/2025



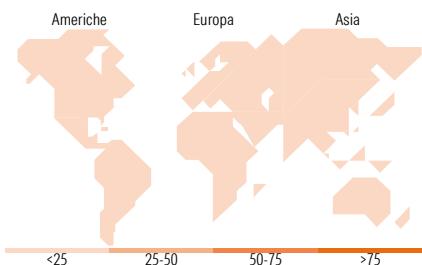
Asset Allocation %	Netta
• Azioni	-0,21
• Obbligazioni	59,86
• Liquidità	43,37
• Altro	-3,02

Fixed Income Style Box™



Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Bills...	-	16,51
United States Treasury Bills...	-	15,91
United States Treasury Bills...	-	13,03
United States Treasury Bills...	-	12,32
United States Treasury Bills...	-	12,28
United States Treasury Bills...	-	9,27
United States Treasury Bills...	-	8,70
MSCI Emerging Markets Index...	-	0,19
Swpb 280826 Gs	-	0,05
Swpsgcoco300126	-	0,04
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		88,29
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0	
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	8	

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo
Governativo
Societario
Cartolarizzazioni
Enti Locali
Liquidità ed equivalenti
Derivati

Coupon Range %

Fondo
0 coupon
Da 0 a 4 cedole
Da 4 a 6 cedole
Da 6 a 8 cedole
Da 8 a 10 cedole
Da 10 a 12 cedole
Oltre 12 cedole

Fondo

Fondo
